clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 003/10

Datum: Frankfurt, 13. Januar 2010
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG, alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, alle Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Aktion erforderlich** ⚠ **Hohe Priorität**

Eurex-EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 035/09, 060/09

Kontakt: Eurex Clearing Risk Operations Hotline, Tel. +49-69-211-1 24 52
Fax +49-69-211-1 84 40, E-Mail: risk@eurexchange.com

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex-EEX Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter neu bestimmt worden und ab dem Batch-Lauf am 13. Januar 2010 gültig.

Das Rundschreiben enthält auch die Margin-Parameter für die im Rundschreiben 060/09 angekündigten neuen Kooperationsprodukte Phelix Base® und Phelix Peak® Futures.

Eurex Clearing AG
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 24 52
F +49-69-211-1 84 40
risk@eurexchange.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender), Jürg Spillmann, Thomas Book, Gary Katz, Thomas Lenz, Michael Peters, Peter Reitz

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

Eurex-EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex-EEX Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und ab dem Batch-Lauf am 13. Januar 2010 gültig:

Additional Margin-Parameter:

F2PE: 1,7 absolut (bleibt konstant)
FCER: 1,3 absolut (sinkt von 1,6)
F1BM: 3,7 absolut (sinkt von 4,4)
F1BQ: 3,9 absolut (bleibt konstant)
F1BY: 3,6 absolut (bleibt konstant)
F1PM: 6,8 absolut (bleibt konstant)
F1PQ: 4,7 absolut (bleibt konstant)
F1PY: 4,2 absolut (bleibt konstant)
F2CR: 1,3 absolut (sinkt von 1,6)
F2EA: 1,7 absolut (bleibt konstant)

Spread Margin-Parameter pro Kontrakt:

F2PE: EUR 300 (sinkt von EUR 400)
FCER: EUR 300 (sinkt von EUR 400)

Der Offset-Faktor für die Margin-Gruppe EMFO bleibt unverändert bei 25 Prozent.

Frankfurt, 13. Januar 2010